

Central Daily Market Report

2023年3月7日(火)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位：億円	2023年3月7日 需給速報	2023年3月8日 需給予想	2023年3月9日 当社予想			
銀行券	400	500	▲ 500			
財政	3,100	▲ 4,000	3,000			
資金過不足	3,500	▲ 3,500	2,500			
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通			6,500	▲ 4,300		
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			1,000			
国債買入	2,700		300			
CP等買入		▲ 100		▲ 100		
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援 社債等買入				▲ 100		
新型コロナウイルス感染症 気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補充供給	▲ 48,600	52,000		58,300		
当増増減	9,500	58,100		2,500		
当座預金残高	5,194,500	5,252,600		5,255,100		
準備預金残高	4,540,000					
積み終了先	4,539,900			3月8日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,539,900			積数	500	
非準備預金先	654,500			1日平均	100	
積み期間(2/16~3/15)の所要準備額						3,515,000
準備預金進捗率	実績	99.99%		日数	71.43%	

●2023年3月7日の市場動向

<インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、邦銀業態を中心に▲0.01~▲0.009%近辺での調達で始まった。▲0.01%ではビッドが厚く底堅い展開となったものの、一巡後は徐々に減少し、▲0.01%を下回る水準でも出合いが見られ、本日の取引を終えた。ターム物はショートタームの引き合いが散見された。

<レポ市場>

GC T/Nは、▲0.095~▲0.085%程度での出合いとなった。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

<短国市場>

7日は短国買入オベが前回と同額の1,000億円でオファーされ、無難な結果となった。マーケットでは動意なく閑散な中、特段の出合いは見られなかった。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測され、発行レートは概ね横ばい圏であった。

●短期金融市場関連指標

2023/3/7	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート	JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円		
	単位:%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値	直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
O/N	▲ 0.060	0.001	▲ 0.011					-	▲ 0.091	0.500	0.000	28,309.16	71.38	135.99-01	135.74-76
T/N			▲ 0.010					-	▲ 0.097						
S/N			▲ 0.008					-	-						
1W	▲ 0.030	0.000	▲ 0.026					-	▲ 0.108						
2W			▲ 0.028					-	▲ 0.118						
3W			0.001					-	▲ 0.130						
1M								-	▲ 0.163						
3M			0.025					▲ 0.185	▲ 0.152						
6M								▲ 0.145	▲ 0.108						
1Y								▲ 0.096	▲ 0.084						
日付		2/28	3/1	3/2	3/3	3/6									
日銀当預残		5,248,800	5,235,500	5,185,200	5,168,000	5,185,000									
準備預金残		4,587,700	4,586,900	4,534,700	4,513,500	4,519,500									
マネタリーベース		6,518,400	6,505,300	6,455,700	6,438,300	6,455,000									
無担O/N加重平均		▲0.011%	▲0.011%	▲0.011%	▲0.010%	▲0.011%									
コール市場残高		202,956	200,667	201,049	211,843	204,806									
うち無担		175,490	170,381	171,829	182,042	176,575									
うちO/N		100,752	91,793	87,081	95,284	91,367									
うち有担		27,466	30,286	29,220	29,801	28,231									

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回・利回較差	案分率	募入平均価格	募入平均利回・利回較差	第1非価格競争入札(億円)
30年利付国債	77	1.600%	9,000	2023/3/8	2052/12/20	21,958.0	7,326.00	103.6500	1.4250%	78.3018%	103.8400	1.4160%	1,669.0

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率*	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国庫短期証券買入	1,000	2023/3/8			4,819	1,000	0.006		0.007	8.9
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※1		2023/3/8		0.000	320	320				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※2		2023/3/8		0.095	0	0				
国債買入(固定利回り方式)(残存期間5年超10年以下)※3		2023/3/8		0.050	0	0				
米ドル資金供給		2023/3/9	2023/3/16	4.830	2	2				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)※4		2023/3/7	2023/3/8	▲1.100	14,130	13,697		▲1.100	▲3.450	
国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2023/3/7	2023/3/8	▲0.350	35,493	35,273		▲0.350	▲0.420	
共通担保資金供給(全店)〈固定金利・金額無制限〉		2023/3/8	2023/3/22	0.000	6,460	6,460				
国債補充供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2023/3/7	2023/3/8	▲0.350	0	0				

*オペの種類が、国債補充供給(国債売現先)の場合は、上限期間利回り、国債買入(固定利回り方式)の場合は、固定利回較差。※1固定利回較差の結果、10年利付国債369回の買入利回りは、0.500%となる。買入金額に制限を設けずオファー。
※2固定利回較差の結果、10年利付国債359回の買入利回りは、0.500%となる。買入金額に制限を設けずオファー。
※3固定利回較差の結果、10年利付国債359回の買入利回りは、0.500%となる。買入金額に制限を設けずオファー。
※4国債補充供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)の売却銘柄は、利付国(10年)第367回(落札額8,499億円、応札額8,932億円)、368回(落札額5,198億円、応札額5,198億円)です。

●2023年3月8日の予定

*1月の国際収支	*1月の米貿易収支	*国庫短期証券(1143回)入札(6ヶ月、45,000億円、3/10発行)
*1月の景気動向指数速報	*米ベージュブック	
*2月の景気ウオッチャー調査	*10-12月期のユーロ圏GDP確報値	

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入